

# 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 (LOF) 2019 年半年度 报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 8 月 23 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 本报告期投资基金情况.....	52

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	53
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.13 投资组合报告附注 .....	53
§8 基金份额持有人信息 .....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	55
§9 开放式基金份额变动 .....	56
§10 重大事件揭示 .....	56
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
§12 备查文件目录 .....	60
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)	
基金简称	南方中证 500ETF 联接(LOF)	
场内简称	南方 500	
基金主代码	160119	
前端交易代码	160119	
后端交易代码	160120	
基金运作方式	上市型开放式(LOF)	
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日	
基金管理人	南方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,986,635,441.59 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 11 月 11 日	
下属分级基金的基金简称	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	南方中证 500ETF 联接(LOF)C
下属分级基金的场内简称	南方 500	
下属分级基金的交易代码	160119	004348
下属分级基金的前端交易代码	160119	
下属分级基金的后端交易代码	160120	
报告期末下属分级基金的份额总额	7,742,649,822.59 份	1,243,985,619.00 份

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方 500”。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 15 日
基金管理人名称	南方基金管理股份有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500ETF”。

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，以中证 500ETF 作为其主要投资标的。为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599
传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	518017	100031
法定代表人	张海波	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 南方基金管理股份有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### 1、南方中证 500ETF 联接(LOF)A

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-65,031,828.17
本期利润	723,790,085.05
加权平均基金份额本期利润	0.1064
本期加权平均净值利润率	8.35%
本期基金份额净值增长率	17.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,001,626,407.38
期末可供分配基金份额利润	0.2585
期末基金资产净值	9,744,276,229.97
期末基金份额净值	1.2585
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	37.31%

#### 2、南方中证 500ETF 联接(LOF)C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-18,559,183.23
本期利润	214,798,230.08
加权平均基金份额本期利润	0.1726
本期加权平均净值利润率	13.72%
本期基金份额净值增长率	17.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	314,528,936.06
期末可供分配基金份额利润	0.2528
期末基金资产净值	1,558,514,555.06
期末基金份额净值	1.2528
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-20.37%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4、本基金从 2017 年 2 月 23 日起新增 C 类份额，C 类份额自 2017 年 2 月 28 日起存续。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

南方中证 500ETF 联接(LOF)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.01%	1.35%	0.75%	1.32%	0.26%	0.03%
过去三个月	-9.72%	1.73%	-10.21%	1.72%	0.49%	0.01%
过去六个月	17.94%	1.70%	17.87%	1.70%	0.07%	0.00%
过去一年	-3.56%	1.60%	-4.70%	1.60%	1.14%	0.00%
过去三年	-15.71%	1.24%	-18.00%	1.25%	2.29%	-0.01%

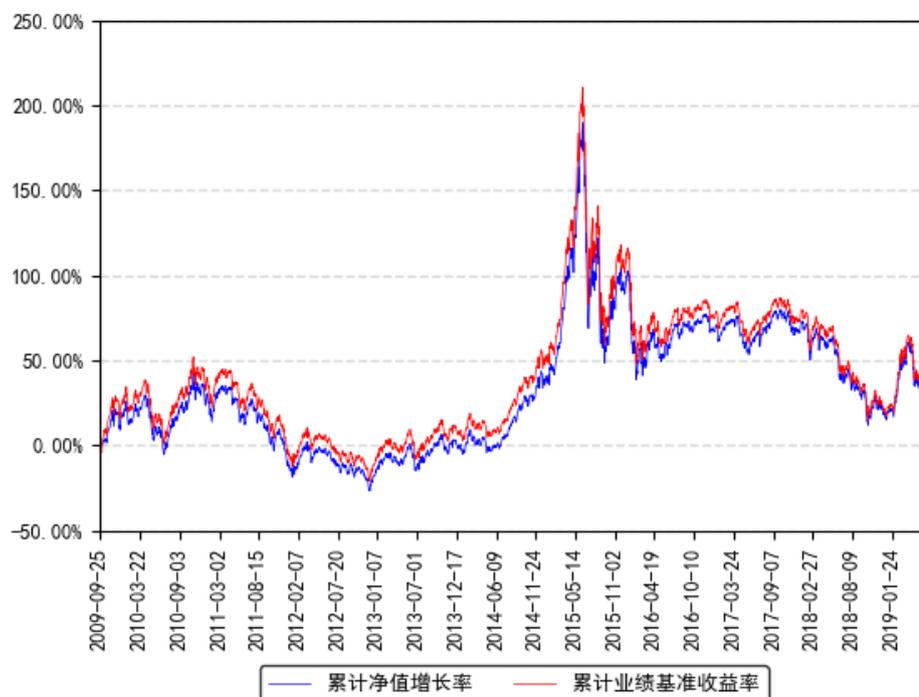
自基金合同生效起至今	37.31%	1.63%	40.25%	1.64%	-2.94%	-0.01%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

南方中证 500ETF 联接 (LOF) C

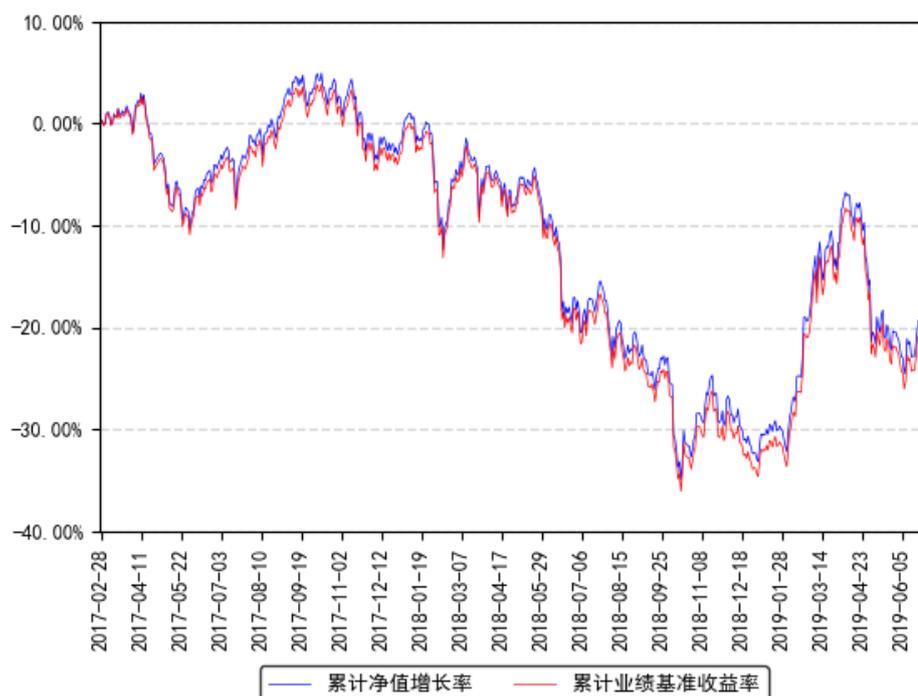
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.98%	1.35%	0.75%	1.32%	0.23%	0.03%
过去三个月	-9.81%	1.73%	-10.21%	1.72%	0.40%	0.01%
过去六个月	17.69%	1.70%	17.87%	1.70%	-0.18%	0.00%
过去一年	-3.95%	1.60%	-4.70%	1.60%	0.75%	0.00%
自基金合同生效起至今	-20.37%	1.33%	-21.99%	1.33%	1.62%	0.00%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

南方中证500ETF联接 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



南方中证500ETF联接(LOF)C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金从2017年2月23日起新增C类份额，C类份额自2017年2月28日起存续。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019年7月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为36172万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司41.16%、深圳市投资控股有限公司27.44%、厦门国际信托有限公司13.72%、兴业证券股份有限公司9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)2.20%。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳、南京等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理股份有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 8800 亿元，旗下管理 191 只开放式基金，多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	14 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有基金从业资格。曾任职于摩根士丹利投资银行，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 4 月起担任数量化投资部基金经理；现任指数投资部总经理。2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2017 年 11 月至 2019 年 1 月，任南方策略、南方量化混合基金经理；2016 年 12 月至 2019 年 4 月，任南方安享绝对收益、南方卓享绝对收益基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500、南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300、南方 300 联接基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2017 年 7 月至今，任恒生联接基金经理；2017 年 8 月至今，任南方房地产联接、南方房地产 ETF 基金经理；2018 年 2 月至今，任 H 股 ETF、南方 H 股 ETF 联接基金经理；2018 年 4 月至今，任 MSCI 基金基金经理；2018 年 6 月至今，任 MSCI 联接基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金

运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律、法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 5 次，是由于投资组合接受投资者申赎后被动增减仓位以及指数成分股调整所致。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证 500 指数涨 18.77%。期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金 A 份额净值为 1.2585 元,报告期内,份额净值增长率为 17.94%,同期业绩基准增长率为 17.87%;本基金 C 份额净值为 1.2528 元,报告期内,份额净值增长率为 17.69%,同期业绩基准增长率为 17.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美联储月底议息会议如期降息,IMF 年内再度下调全球经济增长预期,各国央行相继降息支撑通胀托底经济下行,全球货币政策宽松态势明朗,支撑全球风险资产估值。权益市场资金持续净流入,短期有所减弱,但在 A 股国际化的背景下,预期中长期资金为净流入。同时 A 股市场估值接近历史底部,凸显长期配置价值。

本基金为指数基金,作为基金管理人,我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨,力求实现对标的指数的有效跟踪,为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格,借助投资本基金参与市场。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定,本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术;建立了估值委员会,组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值价格的最终决策。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》;本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;在符合有关基金分红条件

的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配采取现金分红方式；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理股份有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.3.1	737,343,459.86	295,831,756.23
结算备付金		11,090,382.36	3,454,924.63
存出保证金		1,741,271.79	608,132.02
交易性金融资产	6.4.3.2	10,940,187,277.17	6,272,964,818.92
其中：股票投资		171,277,854.01	128,664,864.84
基金投资		10,606,391,439.76	6,098,197,149.08
债券投资		162,517,983.40	46,102,805.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
应收证券清算款		75,962,529.34	11,453,452.57
应收利息	6.4.3.5	3,346,428.00	2,026,201.29
应收股利		-	-
应收申购款		13,151,713.27	10,825,653.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.6	19,341,234.35	5,229,051.94
资产总计		11,802,164,296.14	6,602,393,990.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		75,000,000.00	33,000,000.00
应付证券清算款		-	16,732,390.40

应付赎回款		423,032,683.66	4,079,865.89
应付管理人报酬		288,712.92	203,635.18
应付托管费		57,742.57	40,727.06
应付销售服务费		500,546.99	438,771.72
应付交易费用	6.4.3.7	262,803.02	81,642.00
应交税费		4.83	6.06
应付利息		-	-3,362.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.8	231,017.12	431,701.87
负债合计		499,373,511.11	55,005,377.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.3.9	8,986,635,441.59	6,138,478,178.78
未分配利润	6.4.3.10	2,316,155,343.44	408,910,434.47
所有者权益合计		11,302,790,785.03	6,547,388,613.25
负债和所有者权益总计		11,802,164,296.14	6,602,393,990.69

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，南方中证 500ETF 联接(LOF)A 份额净值 1.2585 元，基金份额总额 7,742,649,822.59 份；南方中证 500ETF 联接(LOF)C 份额净值 1.2528 元，基金份额总额 1,243,985,619.00 份；总份额合计 8,986,635,441.59 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		947,917,432.00	-849,123,891.13
1. 利息收入		3,898,992.51	1,798,575.46
其中：存款利息收入	6.4.3.11	2,289,666.05	988,535.07
债券利息收入		1,609,326.46	810,040.39
资产支持证券利息 收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-88,215,275.84	-7,504,723.57
其中: 股票投资收益	6.4.3.12	26,337,793.66	-12,583,246.00
基金投资收益	6.4.3.13	-115,324,017.82	3,505,933.51
债券投资收益	6.4.3.14	-516,874.07	161,393.72
资产支持证券投资	6.4.3.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.3.16	-	-
衍生工具收益	6.4.3.17	-	-
股利收益	6.4.3.18	1,287,822.39	1,411,195.20
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.3.19	1,022,179,326.53	-845,069,983.03
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.3.20	10,054,388.80	1,652,240.01
减: 二、费用		9,329,116.87	3,366,190.48
1. 管理人报酬	6.4.6.2.1	1,598,598.67	1,247,735.72
2. 托管费	6.4.6.2.2	319,719.71	249,547.14
3. 销售服务费	6.4.6.2.3	3,089,862.16	822,261.48
4. 交易费用	6.4.3.21	3,614,131.23	774,656.34
5. 利息支出		527,644.16	28,366.76
其中: 卖出回购金融资产		527,644.16	28,366.76
支出			
6. 税金及附加		0.53	0.43
7. 其他费用	6.4.3.22	179,160.41	243,622.61
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		938,588,315.13	-852,490,081.61
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以		938,588,315.13	-852,490,081.61

“-”号填列)			
---------	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,138,478,178.78	408,910,434.47	6,547,388,613.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	938,588,315.13	938,588,315.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,848,157,262.81	968,656,593.84	3,816,813,856.65
其中：1. 基金申购款	9,076,448,118.02	2,876,610,073.51	11,953,058,191.53
2. 基金赎回款	-6,228,290,855.21	-1,907,953,479.67	-8,136,244,334.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	8,986,635,441.59	2,316,155,343.44	11,302,790,785.03
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,767,041,393.43	1,497,374,155.70	4,264,415,549.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-852,490,081.61	-852,490,081.61

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“－”号填列）	1,486,197,411.04	652,008,291.48	2,138,205,702.52
其中：1. 基金申购款	2,209,308,174.45	1,016,325,618.88	3,225,633,793.33
2. 基金赎回款	-723,110,763.41	-364,317,327.40	-1,087,428,090.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“－”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,253,238,804.47	1,296,892,365.57	5,550,131,170.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	737,343,459.86
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-

合计	737,343,459.86
----	----------------

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	168,671,814.65	171,277,854.01	2,606,039.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	162,833,993.41	-316,010.01
	银行间市场	-	-
	合计	162,833,993.41	-316,010.01
资产支持证券	-	-	-
基金	11,294,741,475.31	10,606,391,439.76	-688,350,035.55
其他	-	-	-
合计	11,626,247,283.37	10,940,187,277.17	-686,060,006.20

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	245,485.49
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	4,491.63
应收债券利息	3,095,745.64
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	705.24
合计	3,346,428.00

#### 6.4.3.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
可收退补款	-
应收退补款	19,341,234.35
合计	19,341,234.35

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	262,803.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	262,803.02

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	73,906.52
应退退补款	-
预提费用	157,110.60
应付指数使用费	-
可退退补款	-
其他	-
合计	231,017.12

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接(LOF)A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,934,171,169.07	4,934,171,169.07
本期申购	7,487,432,030.44	7,487,432,030.44
本期赎回 (以“-”号填列)	-4,678,953,376.92	-4,678,953,376.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,742,649,822.59	7,742,649,822.59

金额单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接(LOF)C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,204,307,009.71	1,204,307,009.71
本期申购	1,589,016,087.58	1,589,016,087.58
本期赎回（以“-”号填列）	-1,549,337,478.29	-1,549,337,478.29
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,243,985,619.00	1,243,985,619.00

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 未分配利润

单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接(LOF)A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,255,587,894.12	-3,924,296,760.68	331,291,133.44
本期利润	-65,031,828.17	788,821,913.22	723,790,085.05
本期基金份额交易产生的变动数	2,401,717,624.24	-1,455,172,435.35	946,545,188.89
其中：基金申购款	6,407,267,431.22	-4,067,169,826.62	2,340,097,604.60
基金赎回款	-4,005,549,806.98	2,611,997,391.27	-1,393,552,415.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,592,273,690.19	-4,590,647,282.81	2,001,626,407.38

单位：人民币元

南方中证 500ETF 联接(LOF)C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,034,997,157.43	-957,377,856.40	77,619,301.03
本期利润	-18,559,183.23	233,357,413.31	214,798,230.08
本期基金份额交易产生的变动数	35,832,485.35	-13,721,080.40	22,111,404.95
其中：基金申购款	1,354,081,922.75	-817,569,453.84	536,512,468.91
基金赎回款	-1,318,249,437.40	803,848,373.44	-514,401,063.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,052,270,459.55	-737,741,523.49	314,528,936.06

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
----	------------------------------------

活期存款利息收入	2,068,140.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	84,702.78
其他	136,822.73
合计	2,289,666.05

### 6.4.3.12 股票投资收益

#### 6.4.3.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,501,625.16
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	13,836,168.50
合计	26,337,793.66

#### 6.4.3.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,100,317,579.89
减：卖出股票成本总额	2,087,815,954.73
买卖股票差价收入	12,501,625.16

#### 6.4.3.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

#### 6.4.3.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	8,201,557,560.00
减：现金支付申购款总额	4,322,376,375.84
减：申购股票成本总额	3,865,345,015.66
申购差价收入	13,836,168.50

### 6.4.3.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	4,611,594,397.52
减：卖出/赎回基金成本总额	4,726,918,415.34
基金投资收益	-115,324,017.82

### 6.4.3.14 债券投资收益

**6.4.3.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	48,349,497.85
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	46,670,561.90
减：应收利息总额	2,195,810.02
买卖债券差价收入	-516,874.07

**6.4.3.14.2 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.3.14.3 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

**6.4.3.15 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.3.16 贵金属投资收益****6.4.3.16.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.3.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

**6.4.3.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

**6.4.3.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

**6.4.3.17 衍生工具收益****6.4.3.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

**6.4.3.17.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

**6.4.3.18 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,287,822.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,287,822.39

#### 6.4.3.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,022,179,326.53
——股票投资	13,659,554.05
——债券投资	124,446.89
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,008,395,325.59
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
——期货投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,022,179,326.53

#### 6.4.3.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,041,022.76
基金转换费收入	13,366.04
合计	10,054,388.80

注：1 本基金的 A 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中 A 类基金份额场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产；C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产。

#### 6.4.3.21 交易费用

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,207,653.95
银行间市场交易费用	-

交易基金产生的费用	406,477.28
其中：申购费	-
赎回费	-
场内交易费	417.54
其他	406,059.74
合计	3,614,131.23

#### 6.4.3.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	67,440.60
信息披露费	59,917.22
银行费用	22,049.81
上市费	29,752.78
合计	179,160.41

#### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司新增厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽祥企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽益企业管理合伙企业（有限合伙）、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）四名股东，股权结构发生变更。基金管理人已于 2019 年 8 月 1 日发布相关公告。

#### 6.4.5 关联方关系

##### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	42,383,960.09	0.72%	462,758,063.27	25.74%

#### 6.4.6.1.2 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.6.1.3 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.6.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	4,238.88	0.72%	2,754.22	1.05%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	46,280.12	25.74%	23,173.26	35.45%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,598,598.67	1,247,735.72
其中：支付销售机构的客户维护费	1,656,395.06	2,395,722.54

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额

(若为负数, 则取零)的 0.5%年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=(前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) X 0.5% / 当年天数。

#### 6.4.6.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	319,719.71	249,547.14

注: 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费, 支付基金托管人 中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数, 则取零)的 0.1%年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

日托管费=(前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) X 0.1% / 当年天数。

#### 6.4.6.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	合计
华泰证券	-	2,578.33	2,578.33
南方基金	-	2,681,492.89	2,681,492.89
合计	-	2,684,071.22	2,684,071.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	合计
南方基金	-	812,679.03	812,679.03
华泰证券	-	68.59	68.59
合计	-	812,747.62	812,747.62

注: 本基金基金资产中投资于目标 ETF 的部分不收取销售服务费, 支付 C 类基金份额销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%的年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给南方基金, 再由南方基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

**6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
基金合同生效日（2009 年 9 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

份额单位：份

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	南方中证 500ETF 联接 (LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
基金合同生效日（2009 年 9 月 25 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	39,873,972.73	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	50,195.00	-
报告期末持有的基金份额	39,823,777.73	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.94%	-

**6.4.6.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	737,343,459.86	2,068,140.54	241,723,950.39	902,882.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.6.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 1,990,577,002.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 22.03% (2018 年 12 月 31 日：本基金持有 1,366,573,402 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 18.22%)。

#### 6.4.7 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.8 期末（2019 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113027	华钰转债	2019 年 6 月 17 日	2019 年 7 月 10 日	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的

规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### **6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### **6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 75,000,000.00 元，截至 2019 年 7 月 1 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### **6.4.9 金融工具风险及管理**

##### **6.4.9.1 风险管理政策和组织架构**

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0011%(2018 年 12 月 31 日:本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0000%)。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 75,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.0005%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监

会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	737,343,459.86	-	-	-	737,343,459.86
结算备付金	11,090,382.36	-	-	-	11,090,382.36
存出保证金	1,741,271.79	-	-	-	1,741,271.79
交易性金融资产	162,404,034.80	-	113,948.60	10,777,669,293.77	10,940,187,277.17
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,346,428.00	3,346,428.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,053,082.43	-	-	12,098,630.84	13,151,713.27

应收证券清算款	-	-	-	75,962,529.34	75,962,529.34
其他资产	-	-	-	19,341,234.35	19,341,234.35
资产总计	913,632,231.24	-	113,948.60	10,888,418,116.30	11,802,164,296.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	423,032,683.66	423,032,683.66
应付管理人报酬	-	-	-	288,712.92	288,712.92
应付托管费	-	-	-	57,742.57	57,742.57
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	75,000,000.00	-	-	-	75,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	500,546.99	500,546.99
应付交易费用	-	-	-	262,803.02	262,803.02
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4.83	4.83
其他负债	-	-	-	231,017.12	231,017.12
负债总计	75,000,000.00	-	-	424,373,511.11	499,373,511.11
利率敏感度缺口	838,632,231.24	-	113,948.60	10,464,044,605.19	11,302,790,785.03
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	295,831,756.23	-	-	-	295,831,756.23
结算备付金	3,454,924.63	-	-	-	3,454,924.63
存出保证金	608,132.02	-	-	-	608,132.02
交易性金融资产	46,102,805.00	-	-	6,226,862,013.92	6,272,964,818.92
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,026,201.29	2,026,201.29
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,559,490.67	-	-	9,266,162.42	10,825,653.0

					9
应收证券清算款	-	-	-	11,453,452.57	11,453,452.57
其他资产	-	-	-	5,229,051.94	5,229,051.94
资产总计	347,557,108.55	-	-	6,254,836,882.14	6,602,393,990.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,079,865.89	4,079,865.89
应付管理人报酬	-	-	-	203,635.18	203,635.18
应付托管费	-	-	-	40,727.06	40,727.06
应付证券清算款	-	-	-	16,732,390.40	16,732,390.40
卖出回购金融资产款	33,000,000.00	-	-	-	33,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	438,771.72	438,771.72
应付交易费用	-	-	-	81,642.00	81,642.00
应付利息	-	-	-	-3,362.74	-3,362.74
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6.06	6.06
其他负债	-	-	-	431,701.87	431,701.87
负债总计	33,000,000.00	-	-	22,005,377.44	55,005,377.44
利率敏感度缺口	314,557,108.55	-	-	6,232,831,504.70	6,547,388,613.25

注:表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 06 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.44%(2018 年 12 月 31 日: 0.70%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日:同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

##### 6.4.9.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	171,277,854.01	1.52	128,664,864.84	1.97
交易性金融资产-基金投资	10,606,391,439.76	93.84	6,098,197,149.08	93.14
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,777,669,293.77	95.35	6,226,862,013.92	95.10

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）

1.组合自身基准上升 5%	531,298,983.64	343,083,163.33
2.组合自身基准下降 5%	-531,298,983.64	-343,083,163.33

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	171,277,854.01	1.45
	其中：股票	171,277,854.01	1.45
2	基金投资	10,606,391,439.76	89.87
3	固定收益投资	162,517,983.40	1.38
	其中：债券	162,517,983.40	1.38
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	748,433,842.22	6.34
8	其他资产	113,543,176.75	0.96
9	合计	11,802,164,296.14	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,888,302.40	0.02
B	采矿业	6,804,818.95	0.06
C	制造业	93,722,046.08	0.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,631,907.29	0.05
E	建筑业	3,250,429.52	0.03
F	批发和零售业	10,493,767.32	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	8,007,378.13	0.07
H	住宿和餐饮业	859,976.38	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,986,394.72	0.12
J	金融业	6,424,455.38	0.06

K	房地产业	9,099,953.80	0.08
L	租赁和商务服务业	1,883,939.61	0.02
M	科学研究和技术服务业	374,917.29	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,195,749.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	202,865.60	0.00
Q	卫生和社会工作	1,157,483.46	0.01
R	文化、体育和娱乐业	3,571,246.02	0.03
S	综合	2,722,223.06	0.02
	合计	171,277,854.01	1.52

### 7.2.2 期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600872	中炬高新	32,828	1,406,023.24	0.01
2	600536	中国软件	21,600	1,159,272.00	0.01
3	600739	辽宁成大	76,100	1,106,494.00	0.01
4	600201	生物股份	65,716	1,031,084.04	0.01
5	600298	安琪酵母	32,475	1,027,184.25	0.01
6	600183	生益科技	65,342	983,397.10	0.01
7	600642	申能股份	163,463	982,412.63	0.01
8	600426	华鲁恒升	65,654	975,618.44	0.01
9	600763	通策医疗	11,000	974,490.00	0.01
10	603369	今世缘	32,572	908,433.08	0.01
11	600895	张江高科	43,800	898,776.00	0.01
12	600801	华新水泥	43,451	879,882.75	0.01
13	600161	天坛生物	32,817	828,629.25	0.01
14	000860	顺鑫农业	17,639	822,859.35	0.01
15	600879	航天电子	130,800	805,728.00	0.01
16	600549	厦门钨业	54,300	777,033.00	0.01
17	600497	驰宏锌锗	152,600	775,208.00	0.01
18	600325	华发股份	98,368	768,254.08	0.01
19	601168	西部矿业	119,600	763,048.00	0.01
20	603939	益丰药房	10,900	762,891.00	0.01
21	600528	中铁工业	65,560	758,529.20	0.01
22	601128	常熟银行	98,153	757,741.16	0.01
23	600820	隧道股份	119,400	753,414.00	0.01

24	600745	闻泰科技	21,900	727,518.00	0.01
25	600460	士 兰 微	43,800	727,080.00	0.01
26	600392	盛和资源	65,310	722,328.60	0.01
27	601005	重庆钢铁	359,200	721,992.00	0.01
28	600909	华安证券	109,000	712,860.00	0.01
29	600584	长电科技	54,670	702,509.50	0.01
30	600410	华胜天成	65,400	701,742.00	0.01
31	600699	均胜电子	32,838	701,419.68	0.01
32	600572	康 恩 贝	109,200	698,880.00	0.01
33	600718	东软集团	54,382	697,177.24	0.01
34	600875	东方电气	65,420	694,760.40	0.01
35	600811	东方集团	184,831	687,571.32	0.01
36	600673	东 阳 光	87,427	686,301.95	0.01
37	600376	首开股份	76,400	682,252.00	0.01
38	600848	上海临港	21,900	681,747.00	0.01
39	600959	江苏有线	152,250	677,512.50	0.01
40	600315	上海家化	21,732	676,951.80	0.01
41	600839	四川长虹	228,400	673,780.00	0.01
42	600022	山东钢铁	402,660	672,442.20	0.01
43	600166	福田汽车	283,300	671,421.00	0.01
44	601333	广深铁路	206,900	668,287.00	0.01
45	601872	招商轮船	152,100	663,156.00	0.01
46	600567	山鹰纸业	196,000	660,520.00	0.01
47	600755	厦门国贸	76,348	658,883.24	0.01
48	600804	鹏 博 士	87,200	655,744.00	0.01
49	601866	中远海发	239,700	651,984.00	0.01
50	600260	凯乐科技	32,600	651,348.00	0.01
51	600881	亚泰集团	196,063	637,204.75	0.01
52	600808	马钢股份	184,901	630,512.41	0.01
53	002049	紫光国微	14,100	621,951.00	0.01
54	603883	老 百 姓	10,600	619,888.00	0.01
55	600160	巨化股份	86,936	618,114.96	0.01
56	600094	大 名 城	98,000	616,420.00	0.01
57	600521	华海药业	43,700	616,170.00	0.01
58	000066	中国长城	59,632	613,016.96	0.01
59	600967	内蒙一机	54,231	607,387.20	0.01
60	601699	潞安环能	76,000	603,440.00	0.01
61	600486	扬农化工	11,000	601,700.00	0.01
62	603077	和邦生物	315,620	599,678.00	0.01
63	603501	韦尔股份	10,700	587,537.00	0.01
64	600143	金发科技	119,661	586,338.90	0.01
65	600435	北方导航	65,198	586,130.02	0.01
66	600258	首旅酒店	32,481	584,008.38	0.01

67	603000	人 民 网	32,700	583,041.00	0.01
68	600064	南京高科	54,394	582,559.74	0.01
69	600079	人福医药	54,680	574,140.00	0.01
70	600779	水 井 坊	11,248	571,623.36	0.01
71	600282	南钢股份	163,300	571,550.00	0.01
72	600737	中粮糖业	65,317	566,951.56	0.01
73	600021	上海电力	65,289	566,708.52	0.01
74	600026	中远海能	86,800	563,332.00	0.00
75	600037	歌华有线	54,800	561,700.00	0.00
76	601118	海南橡胶	108,600	559,290.00	0.00
77	000401	冀东水泥	31,731	558,782.91	0.00
78	600141	兴发集团	54,200	557,176.00	0.00
79	002463	沪电股份	40,800	555,696.00	0.00
80	601966	玲珑轮胎	32,466	551,922.00	0.00
81	601098	中南传媒	43,536	550,295.04	0.00
82	002129	中环股份	56,300	549,488.00	0.00
83	600863	内蒙华电	174,400	547,616.00	0.00
84	300253	卫宁健康	38,572	546,950.96	0.00
85	600373	中文传媒	43,540	546,862.40	0.00
86	600466	蓝光发展	87,465	544,032.30	0.00
87	600388	龙净环保	43,700	541,443.00	0.00
88	002195	二三四五	138,658	539,379.62	0.00
89	600885	宏发股份	22,125	537,637.50	0.00
90	600171	上海贝岭	32,800	533,000.00	0.00
91	600266	北京城建	65,543	528,276.58	0.00
92	600643	爱建集团	54,840	525,367.20	0.00
93	601231	环旭电子	43,377	522,692.85	0.00
94	300383	光环新网	31,140	522,217.80	0.00
95	002465	海格通信	54,600	520,884.00	0.00
96	601106	中国一重	163,600	513,704.00	0.00
97	000623	吉林敖东	31,300	513,007.00	0.00
98	601718	际华集团	130,900	511,819.00	0.00
99	300450	先导智能	15,200	510,720.00	0.00
100	601000	唐 山 港	184,819	508,252.25	0.00
101	603659	璞 泰 来	10,702	503,208.04	0.00
102	000750	国海证券	99,500	500,485.00	0.00
103	600008	首创股份	141,400	497,728.00	0.00
104	600511	国药股份	21,568	495,416.96	0.00
105	002223	鱼跃医疗	20,116	495,255.92	0.00
106	600649	城投控股	76,400	494,308.00	0.00
107	002507	涪陵榨菜	16,200	494,100.00	0.00
108	600782	新钢股份	98,000	490,000.00	0.00
109	002439	启明星辰	18,168	488,719.20	0.00

110	600500	中化国际	65,162	486,760.14	0.00
111	002268	卫 士 通	19,894	486,408.30	0.00
112	600515	海航基础	97,800	484,110.00	0.00
113	603233	大 参 林	10,653	479,385.00	0.00
114	600039	四川路桥	130,840	476,257.60	0.00
115	600380	健 康 元	54,813	474,132.45	0.00
116	002127	南极电商	42,150	473,766.00	0.00
117	601608	中信重工	108,700	469,584.00	0.00
118	600598	北 大 荒	43,600	467,828.00	0.00
119	002340	格 林 美	99,294	467,674.74	0.00
120	002506	协鑫集成	70,000	467,600.00	0.00
121	002385	大 北 农	88,000	465,520.00	0.00
122	002500	山西证券	57,200	463,320.00	0.00
123	600458	时代新材	44,329	460,578.31	0.00
124	600167	联美控股	43,422	459,404.76	0.00
125	600648	外 高 桥	21,800	457,364.00	0.00
126	000975	银泰资源	34,460	454,527.40	0.00
127	600748	上实发展	54,600	452,634.00	0.00
128	603866	桃李面包	10,811	450,278.15	0.00
129	600216	浙江医药	43,494	445,378.56	0.00
130	600563	法拉电子	10,801	444,677.17	0.00
131	601179	中国西电	120,100	444,370.00	0.00
132	601678	滨化股份	65,446	442,414.96	0.00
133	600348	阳泉煤业	76,100	442,141.00	0.00
134	600056	中国医药	32,768	442,040.32	0.00
135	603228	景旺电子	11,008	440,430.08	0.00
136	601200	上海环境	32,338	440,120.18	0.00
137	600259	广晟有色	10,900	439,270.00	0.00
138	600155	华创阳安	32,600	437,818.00	0.00
139	603517	绝味食品	11,180	435,013.80	0.00
140	000723	美锦能源	41,500	433,675.00	0.00
141	600409	三友化工	76,271	431,693.86	0.00
142	000998	隆平高科	29,800	431,504.00	0.00
143	600827	百联股份	43,886	430,521.66	0.00
144	600777	新潮能源	206,900	430,352.00	0.00
145	002299	圣农发展	16,970	429,680.40	0.00
146	002371	北方华创	6,200	429,350.00	0.00
147	603885	吉祥航空	32,700	428,370.00	0.00
148	600507	方大特钢	43,560	426,016.80	0.00
149	002373	千方科技	24,800	424,080.00	0.00
150	600277	亿利洁能	86,900	423,203.00	0.00
151	000778	新兴铸管	94,700	420,468.00	0.00
152	600970	中材国际	65,254	419,583.22	0.00

153	000686	东北证券	47,500	418,475.00	0.00
154	600717	天津港	65,126	418,108.92	0.00
155	600120	浙江东方	32,818	418,101.32	0.00
156	600138	中青旅	32,883	417,285.27	0.00
157	600312	平高电气	54,232	417,044.08	0.00
158	600845	宝信软件	14,560	414,668.80	0.00
159	603868	飞科电器	10,581	414,246.15	0.00
160	000009	中国宝安	72,541	414,209.11	0.00
161	600525	长园集团	65,286	412,607.52	0.00
162	600062	华润双鹤	32,611	411,224.71	0.00
163	600633	浙数文化	43,881	410,287.35	0.00
164	000997	新大陆	23,940	404,346.60	0.00
165	600823	世茂股份	87,400	402,914.00	0.00
166	002092	中泰化学	50,600	402,776.00	0.00
167	600073	上海梅林	43,400	399,280.00	0.00
168	601869	长飞光纤	10,600	397,500.00	0.00
169	002384	东山精密	27,250	397,032.50	0.00
170	000060	中金岭南	84,600	396,774.00	0.00
171	600418	江淮汽车	76,568	395,090.88	0.00
172	601880	大连港	185,360	394,816.80	0.00
173	603806	福斯特	10,683	392,386.59	0.00
174	000039	中集集团	36,000	384,480.00	0.00
175	000999	华润三九	13,075	383,620.50	0.00
176	600993	马应龙	21,613	381,469.45	0.00
177	000960	锡业股份	34,100	380,897.00	0.00
178	600179	ST 安通	129,860	380,489.80	0.00
179	000690	宝新能源	59,000	379,960.00	0.00
180	002916	深南电路	3,720	379,142.40	0.00
181	002353	杰瑞股份	16,400	378,840.00	0.00
182	000830	鲁西化工	34,810	378,732.80	0.00
183	600060	海信电器	43,900	378,418.00	0.00
184	600759	洲际油气	98,000	378,280.00	0.00
185	002191	劲嘉股份	30,300	376,023.00	0.00
186	600338	西藏珠峰	21,480	375,470.40	0.00
187	600645	中源协和	21,659	374,917.29	0.00
188	002372	伟星新材	21,480	373,752.00	0.00
189	601717	郑煤机	65,192	372,246.32	0.00
190	000729	燕京啤酒	55,600	369,184.00	0.00
191	600580	卧龙电驱	43,811	368,450.51	0.00
192	601958	金钼股份	54,800	367,160.00	0.00
193	600478	科力远	65,600	366,704.00	0.00
194	600006	东风汽车	68,700	366,171.00	0.00
195	600307	酒钢宏兴	179,500	364,385.00	0.00

196	000581	威孚高科	19,600	363,776.00	0.00
197	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.00
198	600664	哈药股份	87,400	361,836.00	0.00
199	600835	上海机电	21,722	360,585.20	0.00
200	002078	太阳纸业	52,800	359,568.00	0.00
201	600597	光明乳业	33,022	354,986.50	0.00
202	601928	凤凰传媒	43,816	353,595.12	0.00
203	601100	恒立液压	11,265	353,495.70	0.00
204	000547	航天发展	36,961	353,347.16	0.00
205	600125	铁龙物流	54,500	351,525.00	0.00
206	600575	皖江物流	119,700	350,721.00	0.00
207	603816	顾家家居	10,980	350,481.60	0.00
208	603515	欧普照明	10,865	350,396.25	0.00
209	600884	杉杉股份	32,900	350,385.00	0.00
210	300168	万达信息	26,800	347,596.00	0.00
211	600751	海航科技	108,900	346,302.00	0.00
212	002281	光迅科技	13,000	344,240.00	0.00
213	600017	日照港	109,100	343,665.00	0.00
214	601611	中国核建	43,800	340,764.00	0.00
215	600582	天地科技	98,234	338,907.30	0.00
216	600729	重庆百货	11,177	337,992.48	0.00
217	600151	航天机电	65,100	335,265.00	0.00
218	600499	科达洁能	76,347	334,399.86	0.00
219	600859	王府井	21,990	334,028.10	0.00
220	002221	东华能源	38,700	333,207.00	0.00
221	000559	万向钱潮	55,600	332,488.00	0.00
222	600901	江苏租赁	54,500	331,905.00	0.00
223	600317	营口港	119,700	330,372.00	0.00
224	601689	拓普集团	21,520	329,686.40	0.00
225	000970	中科三环	29,000	329,150.00	0.00
226	000988	华工科技	20,800	329,056.00	0.00
227	600291	西水股份	32,663	328,589.78	0.00
228	002670	国盛金控	26,063	328,393.80	0.00
229	600267	海正药业	32,805	328,050.00	0.00
230	600557	康缘药业	22,022	327,246.92	0.00
231	000513	丽珠集团	9,809	325,953.07	0.00
232	600565	迪马股份	87,300	325,629.00	0.00
233	300027	华谊兄弟	66,200	325,042.00	0.00
234	300274	阳光电源	34,660	324,071.00	0.00
235	002038	双鹭药业	13,750	323,950.00	0.00
236	300315	掌趣科技	93,000	320,850.00	0.00
237	603486	科沃斯	10,558	319,379.50	0.00
238	300001	特锐德	17,688	318,737.76	0.00

239	601326	秦港股份	87,100	316,173.00	0.00
240	600316	洪都航空	22,085	316,036.35	0.00
241	300088	长信科技	61,900	313,214.00	0.00
242	600787	中储股份	54,482	312,181.86	0.00
243	002690	美亚光电	9,500	309,700.00	0.00
244	000089	深圳机场	34,800	309,372.00	0.00
245	600908	无锡银行	54,600	307,944.00	0.00
246	600329	中新药业	21,518	307,492.22	0.00
247	000878	云南铜业	28,900	307,207.00	0.00
248	300166	东方国信	24,899	306,008.71	0.00
249	002174	游族网络	18,100	305,528.00	0.00
250	600611	大众交通	65,454	304,361.10	0.00
251	002074	国轩高科	23,200	304,152.00	0.00
252	002110	三钢闽光	32,700	304,110.00	0.00
253	603056	德邦股份	21,500	302,720.00	0.00
254	600393	粤泰股份	65,101	302,719.65	0.00
255	600765	中航重机	32,722	302,024.06	0.00
256	600694	大商股份	10,768	300,534.88	0.00
257	002019	亿帆医药	24,500	300,125.00	0.00
258	600195	中牧股份	21,600	299,160.00	0.00
259	000563	陕国投 A	66,970	297,346.80	0.00
260	600862	中航高科	32,800	294,872.00	0.00
261	000636	风华高科	24,200	292,820.00	0.00
262	600770	综艺股份	43,800	292,584.00	0.00
263	002440	闰土股份	23,425	291,875.50	0.00
264	600169	太原重工	108,900	290,763.00	0.00
265	600640	号百控股	21,720	290,613.60	0.00
266	002155	湖南黄金	28,600	288,002.00	0.00
267	600978	宜华生活	75,945	285,553.20	0.00
268	601127	小康股份	21,557	282,396.70	0.00
269	600750	江中药业	21,700	282,317.00	0.00
270	002152	广电运通	41,100	281,535.00	0.00
271	000930	中粮生化	37,400	281,248.00	0.00
272	000732	泰禾集团	16,900	278,850.00	0.00
273	002273	水晶光电	24,060	278,614.80	0.00
274	300316	晶盛机电	21,900	277,911.00	0.00
275	002250	联化科技	24,927	276,440.43	0.00
276	600754	锦江股份	11,200	275,968.00	0.00
277	000598	兴蓉环境	60,600	275,730.00	0.00
278	002589	瑞康医药	36,280	275,365.20	0.00
279	603766	隆鑫通用	65,218	273,263.42	0.00
280	000932	华菱钢铁	56,920	271,508.40	0.00
281	000681	视觉中国	14,000	271,320.00	0.00

282	002002	鸿达兴业	43,600	269,884.00	0.00
283	002131	利欧股份	140,977	269,266.07	0.00
284	002399	海普瑞	12,600	264,474.00	0.00
285	601016	节能风电	98,213	261,246.58	0.00
286	600416	湘电股份	43,341	260,912.82	0.00
287	002583	海能达	31,000	260,090.00	0.00
288	000758	中色股份	46,900	257,481.00	0.00
289	000031	大悦城	40,100	257,442.00	0.00
290	601019	山东出版	33,006	256,786.68	0.00
291	002368	太极股份	8,462	256,398.60	0.00
292	000685	中山公用	29,940	255,687.60	0.00
293	300113	顺网科技	16,300	255,584.00	0.00
294	002266	浙富控股	53,600	254,600.00	0.00
295	000738	航发控制	18,800	251,920.00	0.00
296	600053	九鼎投资	10,791	251,430.30	0.00
297	600623	华谊集团	32,815	250,706.60	0.00
298	000027	深圳能源	40,400	250,480.00	0.00
299	000877	天山股份	21,500	249,830.00	0.00
300	000807	云铝股份	53,100	249,039.00	0.00
301	000008	神州高铁	66,028	248,925.56	0.00
302	300418	昆仑万维	19,300	248,391.00	0.00
303	601001	大同煤业	54,200	247,694.00	0.00
304	600869	智慧能源	54,504	246,358.08	0.00
305	002414	高德红外	12,616	242,227.20	0.00
306	000488	晨鸣纸业	45,019	241,301.84	0.00
307	601311	骆驼股份	22,100	239,785.00	0.00
308	002183	怡亚通	50,100	238,977.00	0.00
309	000887	中鼎股份	24,700	236,873.00	0.00
310	002004	华邦健康	48,700	236,682.00	0.00
311	603568	伟明环保	10,987	236,440.24	0.00
312	603712	七一二	11,100	235,653.00	0.00
313	300182	捷成股份	53,100	234,171.00	0.00
314	002064	华峰氨纶	46,500	233,430.00	0.00
315	002408	齐翔腾达	30,120	233,430.00	0.00
316	600545	卓郎智能	32,791	233,144.01	0.00
317	601615	明阳智能	21,500	233,060.00	0.00
318	600996	贵广网络	21,600	232,848.00	0.00
319	002603	以岭药业	20,100	232,758.00	0.00
320	000528	柳工	34,911	232,507.26	0.00
321	000813	德展健康	30,300	230,886.00	0.00
322	603650	彤程新材	10,500	229,320.00	0.00
323	600158	中体产业	22,300	228,129.00	0.00
324	603355	莱克电气	10,578	227,638.56	0.00

325	002407	多氟多	18,950	224,368.00	0.00
326	600657	信达地产	54,400	224,128.00	0.00
327	600757	长江传媒	32,889	223,974.09	0.00
328	300115	长盈精密	21,290	223,332.10	0.00
329	300010	立思辰	23,665	222,214.35	0.00
330	000028	国药一致	5,311	222,159.13	0.00
331	603328	依顿电子	21,622	222,057.94	0.00
332	000727	华东科技	105,800	221,122.00	0.00
333	002176	江特电机	45,305	220,635.35	0.00
334	603888	新华网	11,050	220,558.00	0.00
335	002244	滨江集团	52,800	219,120.00	0.00
336	002242	九阳股份	10,500	218,505.00	0.00
337	600707	彩虹股份	43,600	218,436.00	0.00
338	002212	南洋股份	15,700	215,090.00	0.00
339	002051	中工国际	18,622	213,594.34	0.00
340	002056	横店东磁	28,000	212,800.00	0.00
341	000156	华数传媒	19,300	212,493.00	0.00
342	300002	神州泰岳	53,200	211,736.00	0.00
343	300026	红日药业	61,100	210,795.00	0.00
344	002505	大康农业	106,700	210,199.00	0.00
345	600350	山东高速	43,408	208,358.40	0.00
346	002491	通鼎互联	25,406	205,534.54	0.00
347	002470	金正大	55,600	202,384.00	0.00
348	600098	广州发展	32,800	202,048.00	0.00
349	000021	深科技	24,800	201,624.00	0.00
350	600428	中远海特	54,360	201,132.00	0.00
351	002030	达安基因	18,716	200,822.68	0.00
352	300058	蓝色光标	47,000	200,690.00	0.00
353	002831	裕同科技	10,466	200,633.22	0.00
354	603198	迎驾贡酒	11,200	200,592.00	0.00
355	300134	大富科技	12,900	200,337.00	0.00
356	601801	皖新传媒	32,909	197,783.09	0.00
357	000012	南玻A	47,465	197,454.40	0.00
358	600971	恒源煤电	32,874	192,312.90	0.00
359	002128	露天煤业	22,200	192,030.00	0.00
360	000712	锦龙股份	14,900	191,316.00	0.00
361	002358	森源电气	18,758	190,393.70	0.00
362	002701	奥瑞金	40,700	190,069.00	0.00
363	002317	众生药业	22,200	188,922.00	0.00
364	002444	巨星科技	18,918	188,801.64	0.00
365	601003	柳钢股份	32,600	188,754.00	0.00
366	000078	海王生物	53,807	187,248.36	0.00
367	002285	世联行	41,500	187,165.00	0.00

368	600058	五矿发展	22,111	186,837.95	0.00
369	601139	深圳燃气	32,800	186,632.00	0.00
370	601777	力帆股份	43,362	186,022.98	0.00
371	300324	旋极信息	32,068	185,673.72	0.00
372	600874	创业环保	22,100	183,209.00	0.00
373	000519	中兵红箭	23,700	183,201.00	0.00
374	002093	国脉科技	19,700	183,013.00	0.00
375	000400	许继电气	20,200	183,012.00	0.00
376	300244	迪安诊断	10,777	182,993.46	0.00
377	000717	韶钢松山	41,000	181,630.00	0.00
378	002426	胜利精密	70,700	180,992.00	0.00
379	600639	浦东金桥	11,185	180,861.45	0.00
380	002672	东江环保	15,750	178,605.00	0.00
381	000926	福星股份	25,800	178,536.00	0.00
382	002573	清新环境	22,108	177,969.40	0.00
383	002640	跨境通	21,300	177,429.00	0.00
384	000718	苏宁环球	51,000	176,460.00	0.00
385	002249	大洋电机	40,300	174,902.00	0.00
386	000006	深振业 A	31,800	173,310.00	0.00
387	002839	张家港行	30,500	171,715.00	0.00
388	000543	皖能电力	36,320	171,067.20	0.00
389	300133	华策影视	25,300	170,269.00	0.00
390	603377	东方时尚	11,120	169,913.60	0.00
391	002028	思源电气	17,018	169,499.28	0.00
392	300197	铁汉生态	47,150	169,268.50	0.00
393	002807	江阴银行	35,880	167,918.40	0.00
394	300055	万邦达	23,500	167,555.00	0.00
395	002280	联络互动	45,200	165,432.00	0.00
396	002366	台海核电	17,600	164,736.00	0.00
397	000848	承德露露	19,660	163,767.80	0.00
398	603877	太平鸟	10,448	162,152.96	0.00
399	000600	建投能源	24,200	162,140.00	0.00
400	000090	天健集团	32,556	160,826.64	0.00
401	600939	重庆建工	32,700	159,903.00	0.00
402	002431	棕榈股份	40,350	159,382.50	0.00
403	000564	供销大集	60,900	158,949.00	0.00
404	300308	中际旭创	4,660	158,393.40	0.00
405	002233	塔牌集团	13,300	155,344.00	0.00
406	300376	易事特	31,300	154,309.00	0.00
407	600335	国机汽车	22,100	152,932.00	0.00
408	002390	信邦制药	29,000	152,830.00	0.00
409	300287	飞利信	38,482	152,773.54	0.00
410	000158	常山北明	27,960	151,543.20	0.00

411	603556	海兴电力	10,950	151,329.00	0.00
412	002745	木林森	12,900	151,188.00	0.00
413	300159	新研股份	30,300	150,894.00	0.00
414	002544	杰赛科技	11,600	150,800.00	0.00
415	002254	泰和新材	14,200	150,236.00	0.00
416	002302	西部建设	13,400	149,276.00	0.00
417	601068	中铝国际	21,600	149,040.00	0.00
418	600126	杭钢股份	32,610	148,701.60	0.00
419	002665	首航节能	43,600	147,804.00	0.00
420	002332	仙琚制药	21,850	147,706.00	0.00
421	300199	翰宇药业	16,000	146,720.00	0.00
422	002424	贵州百灵	14,700	145,236.00	0.00
423	600903	贵州燃气	11,100	144,633.00	0.00
424	000062	深圳华强	10,848	144,169.92	0.00
425	300459	金科文化	25,300	143,957.00	0.00
426	300266	兴源环境	31,642	143,654.68	0.00
427	002709	天赐材料	5,800	140,360.00	0.00
428	000501	鄂武商 A	12,930	138,997.50	0.00
429	000937	冀中能源	35,900	138,574.00	0.00
430	002635	安洁科技	10,150	136,923.50	0.00
431	002048	宁波华翔	12,600	136,332.00	0.00
432	000990	诚志股份	8,300	136,203.00	0.00
433	603225	新凤鸣	10,884	135,941.16	0.00
434	000426	兴业矿业	25,300	135,861.00	0.00
435	002118	紫鑫药业	20,106	135,514.44	0.00
436	002437	誉衡药业	34,300	135,485.00	0.00
437	002375	亚厦股份	22,800	134,748.00	0.00
438	002517	恺英网络	41,900	133,661.00	0.00
439	601811	新华文轩	10,800	131,868.00	0.00
440	000537	广宇发展	18,800	130,096.00	0.00
441	601969	海南矿业	22,000	129,360.00	0.00
442	300257	开山股份	11,600	128,528.00	0.00
443	002815	崇达技术	8,200	127,838.00	0.00
444	000061	农产品	23,100	125,202.00	0.00
445	600985	淮北矿业	11,000	124,740.00	0.00
446	002434	万里扬	18,200	123,578.00	0.00
447	002489	浙江永强	36,650	122,411.00	0.00
448	300297	蓝盾股份	20,300	122,409.00	0.00
449	603569	长久物流	10,500	121,695.00	0.00
450	002503	搜于特	43,000	118,250.00	0.00
451	000536	华映科技	46,900	118,188.00	0.00
452	600280	中央商场	32,900	118,111.00	0.00
453	000980	众泰汽车	27,600	116,196.00	0.00

454	000541	佛山照明	22,130	115,961.20	0.00
455	000766	通化金马	16,100	109,480.00	0.00
456	603025	大豪科技	10,683	109,393.92	0.00
457	000587	金洲慈航	41,400	106,812.00	0.00
458	002509	天广中茂	51,500	106,090.00	0.00
459	002707	众信旅游	17,349	105,308.43	0.00
460	000552	靖远煤电	38,400	104,064.00	0.00
461	002344	海宁皮城	22,000	102,520.00	0.00
462	000829	天音控股	17,600	102,432.00	0.00
463	002512	达华智能	22,400	101,248.00	0.00
464	002482	广田集团	20,527	99,761.22	0.00
465	002818	富森美	7,677	98,495.91	0.00
466	002251	步步高	11,759	93,719.23	0.00
467	002681	奋达科技	21,871	92,733.04	0.00
468	002920	德赛西威	4,000	89,600.00	0.00
469	000987	越秀金控	9,700	87,494.00	0.00
470	002405	四维图新	5,400	86,940.00	0.00
471	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
472	002416	爱施德	12,470	77,937.50	0.00
473	600917	重庆燃气	11,000	76,560.00	0.00
474	000025	特力A	3,646	73,722.12	0.00
475	002699	美盛文化	12,280	73,680.00	0.00
476	002157	正邦科技	4,200	69,972.00	0.00
477	002821	凯莱英	600	58,848.00	0.00
478	000761	本钢板材	12,900	55,470.00	0.00
479	002075	沙钢股份	6,000	47,040.00	0.00
480	002797	第一创业	7,200	45,648.00	0.00
481	002572	索菲亚	2,400	44,544.00	0.00
482	002926	华西证券	4,200	44,100.00	0.00
483	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
484	002387	维信诺	3,000	39,150.00	0.00
485	300009	安科生物	2,400	38,160.00	0.00
486	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
487	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
488	002217	合力泰	6,000	33,180.00	0.00
489	002607	中公教育	2,400	32,952.00	0.00
490	000983	西山煤电	5,400	32,724.00	0.00
491	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
492	002085	万丰奥威	4,200	30,576.00	0.00
493	000883	湖北能源	6,600	28,644.00	0.00
494	000826	启迪环境	2,400	28,296.00	0.00
495	002812	恩捷股份	600	28,050.00	0.00
496	300207	欣旺达	2,400	27,648.00	0.00

497	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
498	002419	天虹股份	1,800	23,508.00	0.00
499	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
500	000301	东方盛虹	4,200	23,058.00	0.00
501	000869	张裕 A	600	19,272.00	0.00
502	000959	首钢股份	5,400	19,008.00	0.00
503	002382	蓝帆医疗	1,200	16,584.00	0.00
504	002941	新疆交建	600	15,600.00	0.00
505	002948	青岛银行	1,800	11,574.00	0.00
506	002936	郑州银行	1,800	9,144.00	0.00
507	002946	新乳业	600	9,084.00	0.00
508	603444	吉比特	25	5,249.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600201	生物股份	40,673,573.41	0.62
2	600426	华鲁恒升	36,871,916.10	0.56
3	600256	广汇能源	35,920,797.00	0.55
4	600872	中炬高新	35,594,534.18	0.54
5	600895	张江高科	34,577,750.20	0.53
6	600642	申能股份	31,775,159.51	0.49
7	600600	青岛啤酒	31,079,719.52	0.47
8	601005	重庆钢铁	30,963,217.83	0.47
9	600879	航天电子	30,724,579.02	0.47
10	600528	中铁工业	29,668,295.45	0.45
11	600298	安琪酵母	29,166,043.02	0.45
12	600325	华发股份	29,137,980.52	0.45
13	600673	东阳光	28,641,247.22	0.44
14	600820	隧道股份	28,055,891.80	0.43
15	600536	中国软件	27,990,544.47	0.43
16	600779	水井坊	27,639,484.99	0.42
17	600572	康恩贝	27,636,645.43	0.42
18	600885	宏发股份	27,195,270.49	0.42
19	600699	均胜电子	27,118,082.06	0.41
20	600875	东方电气	26,498,813.02	0.40

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600201	生物股份	22,211,709.05	0.34
2	600872	中炬高新	20,226,427.27	0.31
3	600426	华鲁恒升	19,729,756.73	0.30
4	600895	张江高科	19,206,855.58	0.29
5	600536	中国软件	18,088,086.26	0.28
6	600642	申能股份	17,535,236.09	0.27
7	600256	广汇能源	17,463,750.72	0.27
8	600879	航天电子	16,736,607.81	0.26
9	600298	安琪酵母	16,575,189.56	0.25
10	601005	重庆钢铁	16,482,137.00	0.25
11	600325	华发股份	16,071,764.32	0.25
12	600528	中铁工业	15,428,891.77	0.24
13	600572	康恩贝	15,379,001.83	0.23
14	600673	东阳光	15,374,648.22	0.23
15	600779	水井坊	15,241,785.40	0.23
16	600820	隧道股份	15,213,664.07	0.23
17	600183	生益科技	14,943,727.90	0.23
18	600460	士兰微	14,698,787.09	0.22
19	600600	青岛啤酒	14,633,846.53	0.22
20	600584	长电科技	14,392,315.10	0.22

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,764,585,775.51
卖出股票收入（成交）总额	2,100,317,579.89

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	53,947,774.20	0.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	108,456,260.60	0.96
	其中：政策性金融债	108,456,260.60	0.96
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	113,948.60	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	162,517,983.40	1.44

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108603	国开 1804	627,810	62,818,668.60	0.56
2	108901	农发 1801	455,920	45,637,592.00	0.40
3	019608	18 国债 26	299,430	29,948,988.60	0.26
4	019611	19 国债 01	240,180	23,998,785.60	0.21
5	110052	贵广转债	690	82,420.50	0.00

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本报告期投资基金情况

### 7.10.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	南方中证 500ETF	股票型	交易型开放式	南方基金管理股份有限公司	10,606,391,439.76	93.84

## 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 7.12.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除安琪酵母（证券代码 600298）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2018 年 8 月 15 日安琪酵母公告，安琪酵母存在未依法履行其他职责违法违规行为，伊犁哈萨克自治州环境保护局根据《中华人民共和国大气污染防治法》第九十九条第二项规定对公司进行公开处罚，罚款人民币 60.00 万元。2018 年 8 月 15 日安琪酵母公告，安琪酵母存在未依法履行其他职责违法违规行为，赤峰市环境保护局根据《酵母工业水污染物排放标准》对公司进行公开处罚，罚款人民币 35.00 万元。2018 年 8 月 11 日安琪酵母公告，安琪酵母存在未依法履行其他职责违法违规行为，崇左市安全生产监督管理局、崇左市环境保护局根据相关法律法规对公司进行公开处罚，罚款人民币 44.556 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.13.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,741,271.79
2	应收证券清算款	75,962,529.34
3	应收股利	-
4	应收利息	3,346,428.00
5	应收申购款	13,151,713.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	19,341,234.35
9	合计	113,543,176.75

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
南方中证 500ETF 联接(LOF)A	500,172	15,479.97	2,976,794,606.81	38.45%	4,765,855,215.78	61.55%
南方中证 500ETF 联接(LOF)C	37,380	33,279.44	1,072,591,565.23	86.22%	171,394,053.77	13.78%
合计	537,552	16,717.70	4,049,386,172.04	45.06%	4,937,249,269.55	54.94%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	吴永强	2,546,021.00	1.94%
2	解强	2,241,875.00	1.71%
3	史丽君	1,267,382.00	0.97%
4	程满富	999,937.00	0.76%
5	何巧英	961,771.00	0.73%
6	郭思含	890,391.00	0.68%
7	郑林祥	800,000.00	0.61%
8	赵秀群	777,626.00	0.59%
9	卢志铭	763,557.00	0.58%
10	张彩玉	741,441.00	0.56%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	7,271,866.12	0.0939%
	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	950,892.02	0.0764%
	合计	8,222,758.14	0.0915%

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	>100
	南方中证 500ETF 联接(LOF)C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	10~50
	南方中证 500ETF 联接	0

	(LOF)C	
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	南方中证 500ETF 联接(LOF)A	南方中证 500ETF 联接 (LOF)C
基金合同生效日(2009 年 9 月 25 日)基金份额总额	3,223,217,818.45	-
本报告期期初基金份额总额	4,934,171,169.07	1,204,307,009.71
本报告期基金总申购份额	7,487,432,030.44	1,589,016,087.58
减：报告期基金总赎回份额	4,678,953,376.92	1,549,337,478.29
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,742,649,822.59	1,243,985,619.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	5,818,948,339.97	99.28%	581,896.53	99.28%	-
华泰证券	1	42,383,960.09	0.72%	4,238.88	0.72%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

#### A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比, 并根据评比的结果选择席位:

1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;

2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实, 投资建议是否准确;

3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安	54,021,946.30	33.17%	1,345,600,000.00	27.18%	-	-	12,937,755,395.14	100.00%
华泰证券	108,856,660.96	66.83%	3,606,000,000.00	72.82%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金关于旗下部分基金增加阳光人寿为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-01-03
2	南方基金关于旗下部分基金增加哈尔滨银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-01-10
3	南方基金关于旗下部分基金增加腾安基金为销	中国证券报	2019-01-24

	售机构的公告		
4	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-02-20
5	南方基金关于旗下部分基金增加恒泰证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-02-20
6	南方基金关于旗下部分基金增加财达证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-02-27
7	南方基金关于旗下部分基金增加东亚银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-03-01
8	南方基金关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-03-21
9	南方基金关于旗下部分基金增加长沙银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-03-28
10	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-04-01
11	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-04-02
12	南方基金关于旗下部分基金增加珠海华润银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-04-25
13	南方基金关于旗下部分基金增加中信银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-04-30
14	南方基金关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-05-28
15	南方基金关于旗下部分基金增加汇林保大为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-06-06
16	南方基金关于旗下部分基金增加青岛银行为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-06-10
17	南方基金关于旗下部分基金增加国开证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-06-14
18	南方基金管理股份有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-25
19	南方基金管理股份有限公司关于深圳富济基金销售有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-25
20	南方基金管理股份有限公司关于深圳宜投基金销售有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-25
21	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	中国证券报	2019-06-25
22	南方基金关于旗下部分基金增加大智慧基金为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-06-25
23	南方基金关于开展机构及企业网上交易部分基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报	2019-06-26
24	南方基金关于旗下部分基金增加中原证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报	2019-06-26

25	南方基金关于调整中国银行各交易渠道基金定投申购费率优惠标准的公告	中国证券报	2019-06-27
26	南方基金管理股份有限公司关于中信建投期货有限公司暂停部分业务的公告	中国证券报	2019-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的文件；
- 2、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 2019 年半年度报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>